



TITLE:

表紙・目次

AUTHOR(S):

CITATION:

表紙・目次. 数理解析研究所講究録 2006, 1477

ISSUE DATE:

2006-03

URL:

<http://hdl.handle.net/2433/48235>

RIGHT:

数理解析研究所講究録 1477

不確実性の下での意思決定と数理モデル

京都大学数理解析研究所

2006年3月

不確実性の下での意思決定と数理モデル
Mathematical Models and Decision Making under Uncertainty
RIMS 研究集会報告集

2005年11月7日～11月9日
研究代表者 高濱 節子 (Setsuko Sakai Takahama)

目 次

1. 確率的比較を用いた制約付き最適化法「確率的変換法」の提案 -----	1
広島修道大・商	阪井 節子(Setsuko Sakai)
広島市立大・情報科学	高濱 徹行(Tetsuyuki Takahama)
2. 最大クリーク問題に関するDNA コンピューティングと行列解析による最適化 --	11
阪大・工	丸山 健悟(Kengo Maruyama)
阪大・情報科学	齋藤 誠慈(Seiji Saito)
〃	小倉 裕介(Yusuke Ogura)
〃	谷田 純(Jun Tanida)
3. A Rendezvous Search on a Linear Graph -----	20
兵庫県立大・経営	菊田 健作(Kensaku Kikuta)
4. 非期待効用の枠組みを用いたリスク回避の一考察 -----	28
阪大・経済学	松村 圭悟(Keigo Matsumura)
5. American-Style Fractional Lookback Options -----	37
北大・経済学	木村 俊一(Toshikazu Kimura)
〃	菊地 一哲(Kazuaki Kikuchi)
6. 数値的逆変換によるインストールメント・オプションの価格評価 -----	47
北大・経済学	木村 俊一(Toshikazu Kimura)
〃	菊地 一哲(Kazuaki Kikuchi)
7. 格付けに応じてクーポンが変化する社債の評価法 -----	55
電通大・電気通信学	矢萩 一樹(Kazuki Yahagi)
〃	宮崎 浩一(Koichi Miyazaki)
8. 金利期間構造モデルとカルマンフィルター ～Frank de Jong and Pedro Santa-Clara 論文に対するコメント～ -----	64
電通大・電気通信学	山下 晃一郎(Koichiro Yamashita)
〃	宮崎 浩一(Koichi Miyazaki)
9. 多目的割当問題のミニマックス最適化 -----	73
防衛大学校	Veerayuth Nomsiri
〃	山田 武夫(Takeo Yamada)
10. Optimal Portfolio Selection by CVaR-Based Sharpe Ratio — Sequential Linear Programming Approach — -----	83
阪大・経済学	林 杉(Shan Lin)
〃	大西 匡光(Masamitsu Ohnishi)

1 1. 多目的ナップサック問題のマックスミン最適化	92
防衛大学校	谷口 史晃(Fumiaki Taniguchi)
〃	片岡 靖詞(Seiji Kataoka)
〃	山田 武夫(Takeo Yamada)
1 2. 最適距離選択について	102
弘前大・理工	金 正道(Masamichi Kon)
1 3. 離散型需要をもつ競合的在庫モデルについて	112
大阪府大・理学系	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
〃	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
1 4. Issues on the Optimal Financial Policy and Incentive in a Firm	118
阪大・経済学	堀川 清之(Kiyoyuki Horikawa)
1 5. A learning algorithm for communicating Markov decision processes with unknown transition matrices	127
宮崎大・教育文化	伊喜 哲一郎(Tetsuichiro Iki)
東京電機大・情報環境	堀口 正之(Masayuki Horiguchi)
千葉大・理	安田 正實(Masami Yasuda)
千葉大・教育	蔵野 正美(Masami Kurano)
1 6. Dynamic Programming creates The Golden Ratio, too	136
九大・経済学	岩本 誠一(Seiichi Iwamoto)
千葉大・理	安田 正實(Masami Yasuda)
1 7. A NOTE ON THE BEST-CHOICE PROBLEM RELATED TO THE WEIGHTED RANDOM PERMUTATION	141
愛知大・経営	玉置 光司(Mitsushi Tamaki)
1 8. セルオートマトンとその応用	
— Chaotic Property of Rule 40 in Wolfram Class I —	149
名工大・おもひ領域	大鏑 史男(Fumio Ohi)
1 9. 不完備情報の多段決定問題 — 公的支出モデルについて	159
九大・経済学	中井 達(Tōru Nakai)
2 0. A Distinction among Stable Equilibria in a Noncooperative Game	168
関西大・工	中井 暉久(Teruhisa Nakai)
2 1. N人売り出しのノイジー・ゲーム	174
大阪府大・理学系	寺岡 義伸(Yoshinobu Teraoka)
〃	北條 仁志(Hitoshi Hohjo)
2 2. 施設に対する査察資源の最適割当を考慮した査察ゲーム	178
防衛大学校	宝崎 隆祐(Ryusuke Hohzaki)
2 3. PLAYERS' INFORMATION IN TWO-PLAYER GAMES OF "SCORE SHOWDOWN"	187
阪大・名誉教授	坂口 実(Minoru Sakaguchi)

2 4. 不完全情報に基づく逐次点検方策について -----	193
鳥取大・工学	石坂 宜宏(Nobuhiro Ishizaka)
鳥取大・工	佐藤 毅(Takashi Satow)
〃	河合 一(Hajime Kawai)
2 5. OSS に対する ANP と SRGM に基づく最適バージョンアップ時期の 推定問題に関する一考察 -----	199
鳥取環境大・環境情報	田村 慶信(Yoshinobu Tamura)
鳥取大・工	山田 茂(Shigeru Yamada)
2 6. Estimating Age Replacement Policies with a Censored Small Sample Data -----	208
広島大・工学	林坂 弘一郎(Koichiro Rinsaka)
〃	土肥 正(Tadashi Dohi)
2 7. 2 種の期日遅れコストをもつ待ちを伴う仕事の最適処理政策 -----	217
鳥取大・工	小柳 淳二(Junji Koyanagi)
〃	河合 一(Hajime Kawai)
2 8. 有効ターム数の確率的解析 (Probabilistic Analyses on the Number of Reliable Rules and the Needed Data Size) -----	223
京大・情報学	原口 和也(Kazuya Haraguchi)
名大・情報科学	柳浦 睦憲(Mutsunori Yagiura)
2 9. 多目的確率計画問題に対する二次確率優越に基づくパレート最適解と 対話型ファジィ満足化 -----	232
広島大・工学	加藤 浩介(Kosuke Kato)
〃	坂和 正敏(Masatoshi Sakawa)
〃	片桐 英樹(Hideki Katagiri)
〃	宇野 剛史(Takeshi Uno)
シャープ株式会社	小川 篤(Atsushi Ogawa)
3 0. ファジィ線形計画問題と灰色線形計画問題について -----	240
金沢学院大・経営情報	桑野 裕昭(Hiroaki Kuwano)
3 1. 複数の決定表のラフ集合解析：グループ決定への応用に向けて -----	249
阪大・基礎工学	乾口 雅弘(Masahiro Inuiguchi)